

onemarkets Fidelity World Equity Income Fund – Vorlage für die vorvertragliche Offenlegung von Finanzprodukten gemäß Artikel 8, Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6, Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852

Name des Produkts:

onemarkets Fidelity World Equity Income Fund

Unternehmenskennung:

5299009COHSZRTC04M52

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifizierungssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? *[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht der Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen]*

Ja

Nein

Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____ %

Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale** beworben, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 20 % an nachhaltigen Investitionen.

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____ %

Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt.



Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale durch Investition in Wertpapiere von Emittenten mit günstigen ESG-Merkmalen. Günstige ESG-Merkmale werden durch Betrachtung der ESG-Ratings ermittelt. ESG-Ratings berücksichtigen ökologische Merkmale wie Kohlenstoffintensität, Kohlenstoffemissionen, Energieeffizienz, Wasser- und Abwasserwirtschaft und Artenvielfalt sowie soziale Merkmale wie Produktsicherheit, Lieferkette, Gesundheit und Sicherheit und Menschenrechte.

Der Teilfonds beabsichtigt, teilweise nachhaltige Investitionen gemäß Artikel 2 (17) der Offenlegungsverordnung zu tätigen.

Für die Einhaltung der beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurde kein Referenzwert festgelegt.

Mit den **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?**

Der Teilfonds verwendet die folgenden Nachhaltigkeitsfaktoren, um die Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen:

i) den prozentualen Anteil des Teilfonds, der in Wertpapiere von Emittenten mit günstigen ESG-Merkmalen gemäß des Fidelity Sustainable Investing Framework angelegt ist.

Aus ökologischer Sicht berücksichtigen wir zahlreiche Faktoren, einschließlich der Vorgehensweise und der Richtlinien der Emittenten hinsichtlich der Bekämpfung des Klimawandels und des Verlusts an Artenvielfalt sowie deren Ansätze bei der Energieeffizienz und der Vermeidung von Abfall und Verschmutzung. Hinsichtlich der sozialen Verantwortung von Emittenten betrachten wir deren Richtlinien zur Vielfalt, deren Haltung zu Menschenrechten und dem Lieferkettenmanagement sowie deren Ansätze bei den Themen Gesundheit, Sicherheit und Mitarbeiterwohlbefinden. Zudem analysieren wir die Umsetzung des Datenschutzes und der Cyber-Sicherheit durch Emittenten, sowohl im Technologiesektor als auch generell über andere Branchen hinweg. Diese ESG-Analyse nutzt die umfassenden Research-Möglichkeiten von Fidelity sowie unseren laufenden Austausch mit Emittenten, um mit Unterstützung des Know-hows des Teams Sustainable Investing eine vorwärts gerichtete Bewertung der Ergebnisse und des Entwicklungspfads eines Emittenten bei Nachhaltigkeitsthemen zu liefern.

Der Teilfonds muss mindestens 75 % seines Nettovermögens in Emittenten (sowohl Unternehmen als auch staatliche Einrichtungen) investieren, die gute 'Nachhaltigkeitsmerkmale' aufweisen; diese sind wie folgt definiert:

1. Anlagen mit einem MSCI-ESG-Rating von AAA→BBB für Wertpapiere aus entwickelten Märkten
2. Anlagen mit einem MSCI-ESG-Rating von AAA→BB für Wertpapiere aus nicht entwickelten Märkten und
3. Liegt kein MSCI-ESG-Rating vor, wird das Fidelity Nachhaltigkeits-Rating verwendet. Das Fidelity Nachhaltigkeits-Rating bewertet Anlagen mit einem Rating von A→C als Anlagen mit guten Nachhaltigkeitsmerkmalen.

Emittenten, deren Bewertung keine positiven Nachhaltigkeitsmerkmale zur Erreichung des primären Ziels (mindestens 75 % des Nettovermögens) bestätigt, können mit bis zu 25 % des Nettovermögens in den Fonds aufgenommen werden, sofern sie nachweisen können, dass sie sich hinsichtlich ihrer Nachhaltigkeitsmerkmale auf einem Weg der Verbesserung befinden. Emittenten mit Verbesserung der Nachhaltigkeitsindikatoren werden anhand des für sie durch die Fidelity Nachhaltigkeits-Ratings prognostizierten Entwicklungspfads als solche klassifiziert, oder es handelt sich hierbei um Emittenten, die unserer Ansicht nach durch Einführung und Anwendung eines formalen Mitwirkungsplans ein Verbesserungspotential nachweisen. Derartige Mitwirkungspläne müssen zentrale Ziele und Meilensteine zur Bestätigung der angestrebten Verbesserung enthalten und auf der internen Research-Plattform von Fidelity dokumentiert werden. Wenn ein derartiges Engagement nicht innerhalb eines festgelegten Zeitraums zu einer Verbesserung der Nachhaltigkeitsmerkmale des Emittenten geführt hat, wird das Wertpapier gemäß der Ausschlussvorgaben von Fidelity zur Veräußerung freigegeben.

Kontroversen hinsichtlich ökologischer und sozialer Merkmale werden regelmäßig überwacht. Ökologische und soziale Merkmale werden durch die Fundamentaldatenanalysten von Fidelity geprüft und anhand der Fidelity Nachhaltigkeitsbewertungen beurteilt:

1. bei direkten Investitionen in Unternehmensemittenten, der prozentuale Anteil des Teilfonds, der in Wertpapieren von Emittenten mit möglichen Ausschlusspositionen angelegt ist (siehe nachfolgende Definition)
2. der prozentuale Anteil des Teilfonds, der in ökologisch nachhaltige Investitionen angelegt ist und
3. der prozentuale Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem sozialen Ziel.

● ***Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Der Teilfonds definiert eine nachhaltige Investition wie folgt:

1. Emittenten, die wirtschaftliche Aktivitäten unterhalten, die zu einem oder mehreren der in der EU-Taxonomie festgelegten ökologischen Zielen beitragen und gemäß der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten (der Teilfonds hat sich aktuell nicht zur Investition in Anlagen verpflichtet, die an der EU-Taxonomie ausgerichtet sind); oder
2. Emittenten, bei denen die Mehrheit der unternehmerischen Aktivitäten (mehr als 50 % der Erträge) zu ökologischen oder sozialen Zielen gemäß einem oder mehreren der Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) beitragen, werden als nachhaltige Investition gemäß der Strategie des Teilfonds betrachtet. Die Gesamtposition gilt hinsichtlich der Allokationslimiten als nachhaltig; oder
3. Emittenten, die ein Dekarbonisierungsziel entsprechend einem 1,5 Grad-Erwärmungsszenario oder niedriger festgelegt haben (Bestätigung durch die Wissenschaftsbasierte Zielinitiative oder ein von Fidelity entwickeltes Klimarating), was als Beitrag zu ökologischen Zielen betrachtet wird;

sofern sie keinen wesentlichen Schaden verursachen und Mindestschutzstandards sowie Kriterien für verantwortungsvolle Unternehmensführung erfüllen.

Bei den
**wichtigsten
nachteiligen
Auswirkungen**

handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern werden die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, keinem der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele erheblich schaden?

Nachhaltige Investitionen werden geprüft auf die Beteiligung an Aktivitäten, die signifikanten Schaden und Kontroversen verursachen, sowie durch eine Überprüfung, ob der Emittent einen Mindestschutz sicherstellt und Standards einhält, die sich auf die wichtigsten nachteiligen Indikatoren (PAIs) wie auch die Ergebnisse bei den PAI-Kennzahlen beziehen. Hierzu gehören:

Normbasierte Überprüfungen - Ausschluss von Wertpapieren auf der Grundlage der bestehenden normbasierten Überprüfungen von Fidelity (siehe nachfolgende Beschreibung);

Mit den Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Aktivitätenbasierte Überprüfungen - Ausschluss von Emittenten aufgrund ihrer Beteiligung an Aktivitäten mit wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf die Gesellschaft oder die Umwelt, einschließlich Emittenten, die gemäß einer Kontroversen-Prüfung 'sehr schwerwiegende' Kontroversen aufweisen im Hinblick auf 1) ökologische Themen, 2) Menschenrechte und Gemeinschaften, 3) Arbeitsrecht und Lieferkette, 4) Kunden, 5) gute Unternehmensführung; und

PAI-Indikatoren: Quantitative Daten (sofern verfügbar) zu PAI-Indikatoren werden verwendet, um zu beurteilen, ob ein Emittent an Aktivitäten beteiligt ist, die ökologische oder soziale Ziele wesentlich beeinträchtigen.

Darüber hinaus wendet der Teilfonds sektorbasierte Ausschlüsse an, die nachfolgend ausführlich erläutert werden.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Bei den oben beschriebenen nachhaltigen Investitionen nimmt Fidelity eine quantitative Bewertung vor, um Emittenten mit einer kritischen Bilanz bei PAI-Indikatoren zu ermitteln. Emittenten mit einem niedrigen Wert können nicht als 'nachhaltige Investition' betrachtet werden, sofern nicht die Fundamentaldatenanalyse von Fidelity zu der Schlussfolgerung kommt, dass der Emittent die Anforderungen, keine wesentlichen Schaden zu verursachen, nicht verletzt oder sich durch ein effektives Management oder eine entsprechende Transformation auf dem Weg zu Milderung der nachteiligen Auswirkungen befindet.

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:

Normbasierte Überprüfungen werden angewendet: Emittenten, bei denen festgestellt wurde, dass ihr Verhalten nicht in Einklang steht mit ihrer grundlegenden Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung gemäß internationaler Normen, einschließlich der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und der UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte, des UN Global Compact (UNGC) und der Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO), gerecht werden, werden nicht als nachhaltige Investitionen betrachtet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz der "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz der "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die Investitionen, die dem übrigen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige wirtschaftliche Aktivitäten nicht.

Jegliche weiteren nachhaltigen Anlagen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht signifikant beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

- Ja, wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI) auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden bei Anlageentscheidungen berücksichtigt bzw. in diese einbezogen mit Hilfe einer Reihe von Instrumenten; hierzu gehören:
1. Due Diligence - Analyse, ob wesentliche und negative nachteilige Auswirkungen vorliegen.
 2. ESG-Rating - Fidelity verwendet ESG-Ratings, die wichtige nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen, z. B. Kohlenstoffemissionen, Arbeitssicherheit, Bestechung und Korruption, Wasserwirtschaft. Bei Wertpapieren, die von Staaten ausgegeben werden, werden wichtigste nachteilige Auswirkungen bei Anlageentscheidungen berücksichtigt bzw. in diese einbezogen mit Hilfe von Ratings, die wichtige nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen, z. B. Kohlenstoffemissionen, Beeinträchtigung gesellschaftlicher Rechte und Redefreiheit.
 3. Ausschlüsse - Bei Direktinvestitionen in Unternehmensemittenten wendet der Teilfonds Ausschlüsse an (siehe nachfolgende Definition), um durch Ausschluss Schaden verursachender Branchen und das Verbot von Investitionen in Emittenten, die internationale Normen wie den UNGC verletzen, zur Milderung wesentlicher nachteiliger Auswirkungen beizutragen.
 4. Engagement - Fidelity setzt sein Engagement als Mittel ein, um wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren besser zu verstehen und, in manchen Fällen, die Anwendung und Ausweitung der Kennzahlen zu wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Nachhaltigkeit zu fördern. Fidelity beteiligt sich an relevanten individuellen oder gemeinsamen Initiativen, die eine Reihe von wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bekämpfen (z. B. Climate Action 100+, Investors Against Slavery and Trafficking APAC).
 5. Stimmrechtsverhalten - Fidelity nutzt seine Stimmrechte zur Förderung ausdrücklicher Mindeststandards für die Geschlechtervielfalt in Vorständen und die Bekämpfung des Klimawandels. Darüber hinaus kann Fidelity seine Stimmrechte zur Stärkung der Bilanz von Emittenten bei anderen Indikatoren einsetzen.
 6. Vierteljährliche Überprüfungen - Überwachung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen durch den vierteljährlichen Überprüfungsprozess des Teilfonds.

Die konkreten Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen, die berücksichtigt werden, sind abhängig von der Verfügbarkeit von Daten und können sich mit verbesserter Qualität und Verfügbarkeit von Daten weiterentwickeln. Unter gewissen Umständen, z. B. bei Direktinvestitionen des Teilfonds, werden wichtigste nachteilige Auswirkungen unter Umständen nicht berücksichtigt.

Die betreffende Richtlinie, in der Vorgaben zu wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren festgelegt sind, ist online verfügbar unter:

<https://www.structuredinvest.lu/de/en/fund-platform/esg.html>

Weitere Informationen zu wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden entsprechend Art. 11 (2) der Verordnung (EU) 2019/2088 in einem Anhang zum Geschäftsbericht des Fonds veröffentlicht.

Nein



Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Mindestens 90 % des Nettovermögens des rechtlich getrennten Teilfonds werden dahingehend analysiert, ob sie ESG-Merkmale aufweisen, und mindestens 75 % des Nettovermögens des Teilfonds werden in Wertpapiere investiert, die Nachhaltigkeitsmerkmale (Beschreibung siehe unten) ausweisen. Das durchschnittliche ESG-Rating des Teilfonds ist höher als das durchschnittliche ESG-Rating des Anlageuniversums des Teilfonds nach Ausschluss von 20 % der Anlagen mit den niedrigsten ESG-Ratings. Günstige ESG-Merkmale werden durch Betrachtung der ESG-Ratings ermittelt, die von externen Agenturen bereitgestellt werden oder auf den ESG-Ratings von Fidelity basieren.

Innerhalb dieses Anlageuniversums wählt der Anlageverwalter durch eine konsequente Bottom-Up-Finanzanalyse und Bewertung diejenigen Titel mit dem größten Renditepotential aus.

Bei Direktinvestitionen in Unternehmensemittenten ist der Teilfonds an folgende Auflagen gebunden:

1. eine unternehmensweite Ausschlussliste, die folgende Emittenten enthält:
 - a. Emittenten, die Erträge aus der Herstellung kontroverser Waffen (biologische Waffen, chemische Waffen, Brandwaffen, abgereichertes Uran, nicht detektierbare Fragmente, Laser-Blendwaffen, Streumunition, Landminen und Nuklearwaffen) erzielen;
 - b. Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Erträge aus der Herstellung konventioneller Waffen (eine Kriegswaffe, die nicht nuklear, chemisch oder biologisch ist) erzielen;
 - c. Emittenten, die Erträge aus der Herstellung halbautomatischer Schusswaffen erzielen, die zum Verkauf an Zivilisten kommen, oder die mehr als 5 % ihrer Erträge aus dem Verkauf halbautomatischer Schusswaffen an Zivilisten erzielen;
 - d. Emittenten, die Erträge aus der Tabakherstellung erzielen, oder Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Erträge aus dem Weiterverkauf, dem Vertrieb oder der Lizenzierung von Tabak erzielen; oder
 - e. Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Erträge aus der Förderung von und Stromerzeugung mit Kraftwerkskohle erzielen, wobei Emittenten zugelassen sind, die weniger als 30 % ihrer Erträge aus der Förderung von und Stromerzeugung mit Kraftwerkskohle erzielen, sofern: (i) der Anteil der Erträge aus Aktivitäten mit erneuerbaren Energien den Anteil der Erträge aus Aktivitäten mit Kraftwerkskohle übersteigt, oder (ii) der Emittent sich zu einem der Ziele des Übereinkommens von Paris basierend auf wissenschaftsbasierten Zielen oder zur Ausrichtung auf ein Szenario der Transition Pathway Initiative verpflichtet hat oder eine angemessene gleichwertige öffentliche Verpflichtung eingegangen ist; und
2. eine normbasierte Überprüfung von Emittenten, die nach Einschätzung des Anlageverwalters ihr Geschäft nicht in Einklang mit internationalen Normen, einschließlich der Normen des UNGC, geführt haben.

Die voranstehend aufgeführten Ausschlüsse und Überprüfungen (die "Ausschlüsse") können von Zeit zu Zeit aktualisiert werden. Weitere Informationen zu dem Sustainable Investing Framework sind der Website www.fidelityinternational.com zu entnehmen.

3. die Ausschluss-Richtlinie der UniCredit Group gemäß Artikel 1.14(f) und Anhang K der Anlageverwaltungsvereinbarung, die am 1. August 2022 zwischen Structured Invest S.A. und FIL (Luxembourg) S.A. eingegangen wurde und am 15. September 2022 in Kraft trat.

Der Anlageverwalter kann nach eigenem Ermessen von Zeit zu Zeit erweiterte, strengere Nachhaltigkeitsanforderungen und Ausschlüsse umsetzen.

● ***Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?***

Der Teilfonds investiert:

1. mindestens 75 % seines Vermögens in Emittenten mit günstigen ESG-Merkmalen, darunter
2. mindestens 20 % in nachhaltige Anlagen, von denen mindestens 0 % ein ökologisches Ziel (gemäß der EU-Taxonomie), mindestens 5 % ein ökologisches Ziel (nicht gemäß der EU-Taxonomie) und mindestens 5 % ein soziales Ziel gemäß Artikel 2 (17) der Offenlegungsverordnung haben müssen.

Darüber hinaus wendet der Teilfonds Ausschlusskriterien für Unternehmen und/oder Länder und/oder Basiswerte an, in die keine oder nur bis zu einem vordefinierten Limit Investitionen vorgenommen werden sollten.

1. Unternehmen, die an schwerwiegenden Verletzungen des UN Global Compact beteiligt sind.
2. Unternehmen, die nach der Definition internationaler Verpflichtungen, Verträge und Gesetze an der Herstellung, Wartung oder dem Handel mit kontroversen und/oder moralisch verwerflichen Waffen beteiligt sind.
3. Unternehmen, die an der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder der Energieerzeugung aus Kraftwerkskohle beteiligt sind und mit dieser Tätigkeit mehr als 10 % ihrer konsolidierten Erträge erzielen. Hierbei gilt zudem ein obligatorischer Ausstieg bis 2028.
4. Unternehmen, die an der Herstellung kontroverser Brennstoffe beteiligt sind, und Unternehmen, die Kohlenwasserstoffe mit kontroversen Verfahren oder in Regionen mit starken ökologischen Auswirkungen fördern (es kann eine *De-minimis*-Regel angewandt werden, d. h. Unternehmen mit einer geringfügigen Beteiligung werden nicht zwangsläufig ausgeschlossen, und der interne Schwellenwert auf Seiten der Verwaltungsgesellschaft wird auf 5 % festgesetzt).
5. Unternehmen, die an der Tabakherstellung beteiligt sind und mit dieser Tätigkeit mehr als 5 % ihrer konsolidierten Erträge erzielen.
6. Unternehmen, die an Erzeugung von Kernenergie beteiligt sind und mit dieser Tätigkeit mehr als 15 % ihrer konsolidierten Erträge erzielen.
7. Unternehmen, die an der Herstellung von Waffen beteiligt sind und mit dieser Tätigkeit mehr als 10 % ihrer konsolidierten Erträge erzielen.
8. Unternehmen, die im Glücksspielgeschäft tätig sind und mit dieser Tätigkeit mehr als 15 % ihrer konsolidierten Erträge erzielen.
9. Unternehmen, die im Erotikgeschäft tätig sind und mit dieser Tätigkeit mehr als 15 % ihrer konsolidierten Erträge erzielen.

● ***Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?***

Nicht zutreffend. Für den Teilfonds ist kein Mindestsatz festgelegt.

Die **Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.

● **Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?**

Die Verfahrensweisen der guten Unternehmensführung von Emittenten werden unter Verwendung der Fundamentaldatenanalyse, einschließlich Fidelity ESG-Ratings, sowie unter Verwendung von Daten zu Kontroversen und zu Verletzungen des UN Global Compact bewertet.

Zu den wichtigsten Faktoren, die dabei untersucht werden, zählen unter anderem die bisherige Kapitalallokation, Finanztransparenz, Transaktionen mit verbundenen Parteien, Unabhängigkeit und Größe des Verwaltungsrats, Vergütung von Führungskräften, Rechnungsprüfer und interne Aufsicht, Rechte von Minderheitsaktionären.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

(# 1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale) Der Teilfonds investiert:

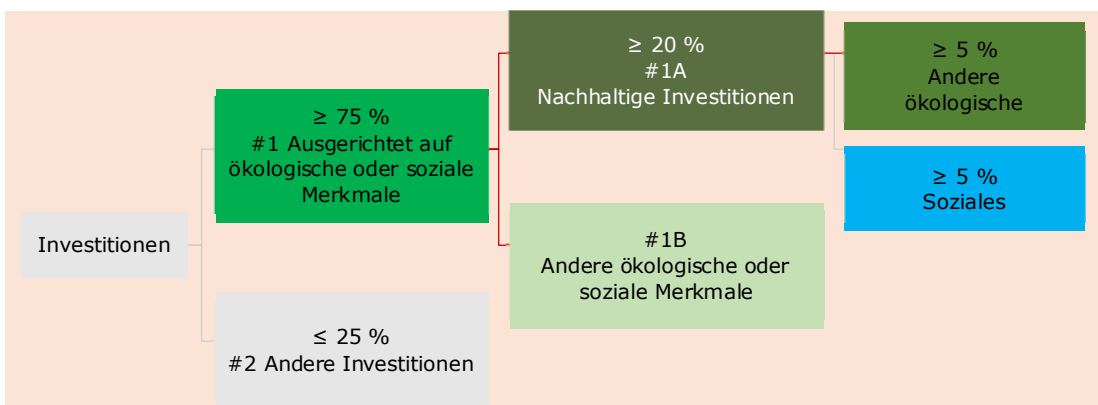
1. mindestens 75 % seines Vermögens in Wertpapiere von Emittenten mit günstigen ESG-Merkmalen, darunter
2. mindestens 20 % in nachhaltige Anlagen (# 1A Nachhaltige Investitionen)* von denen mindestens 0 % ein ökologisches Ziel (entsprechend der EU-Taxonomie), mindestens 5 % ein ökologisches Ziel (nicht entsprechend der EU-Taxonomie) und mindestens 5 % ein soziales Ziel haben.

(# 1B Andere ökologische oder soziale Merkmale) Umfasst Wertpapiere von Emittenten mit günstigen ESG-Merkmalen, die aber keine nachhaltigen Investitionen darstellen.

*Fidelity bestimmt den Gesamt-Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen unter Einbeziehung von Emittenten, wie voranstehend beschrieben, bei denen mehr als 50 % der Erträge zu einem nachhaltigen Anlageziel beitragen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

- **Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?**

Sofern das Wertpapier, das einem Derivat zugrunde liegt, ein günstiges ESG-Merkmal nach dem Sustainable Investing Framework von Fidelity aufweist, kann das Derivat bei der Bestimmung des Anteils des Teilfonds berücksichtigt werden, der der Förderung ökologischer oder sozialer Merkmale dient.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

- **Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie³ investiert?**

Ja:

In fossiles Gas

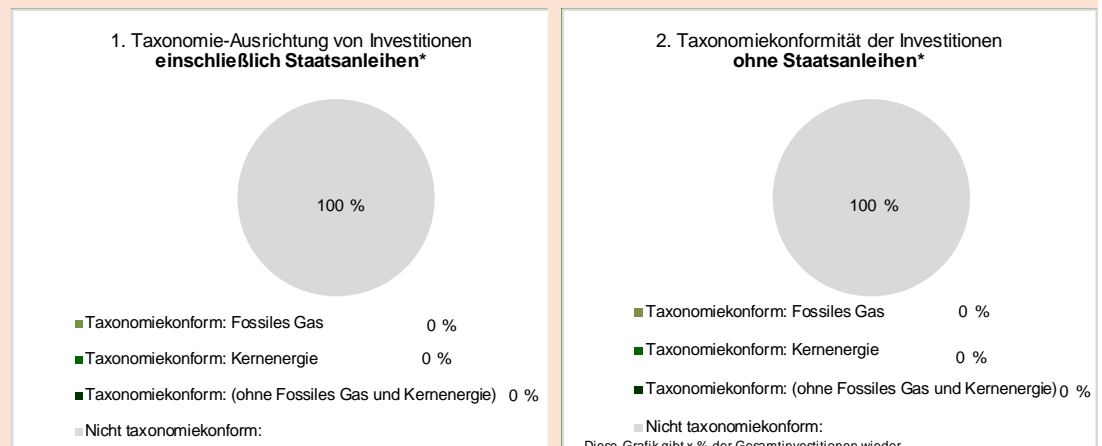
In Kernenergie

Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

³ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

● **Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

Der Teilfonds investiert mindestens 0 % in Übergangstätigkeiten und mindestens 0 % in ermöglichende Tätigkeiten.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Teilfonds investiert mindestens 5 % in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind.

Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind, sind Investitionen in Emittenten,

- bei denen die Mehrheit der unternehmerischen Aktivitäten (mehr als 50 % der Erträge) zu ökologischen oder sozialen Zielen gemäß einem oder mehreren der Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) beitragen oder
- die ein Dekarbonisierungsziel entsprechend einem 1,5 Grad-Erwärmungsszenario oder niedriger festgelegt haben (Bestätigung durch die Wissenschaftsbasierte Zielinitiative oder ein von Fidelity entwickeltes Klima-Rating), was als Beitrag zu ökologischen Zielen betrachtet wird.

Es besteht ferner die Möglichkeit, dass Investitionen mit der EU-Taxonomie konform sind, der Anlageverwalter jedoch aktuell nicht in der Lage ist, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Teilfonds anzugeben, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Eine derartige Position wird jedoch entsprechend der Finalisierung der Basiswertregeln und der zunehmenden Verfügbarkeit verlässlicher Daten regelmäßig überprüft.

Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds investiert mindestens 5 % in nachhaltige Anlagen mit einem sozialen Ziel gemäß Artikel 2 (17) der Offenlegungsverordnung. Nachhaltige Anlagen mit einem sozialen Ziel sind Investitionen in Emittenten, bei denen die Mehrheit der unternehmerischen Aktivitäten (mehr als 50 % der Erträge) zu ökologischen oder sozialen Zielen gemäß einem oder mehreren der Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) beitragen.

Welche Investitionen fallen unter "#2 Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die verbleibenden Investitionen des Teilfonds erfolgen in Titel, die auf das Finanzziel des Teilfonds ausgerichtet sind, in Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Zweck der Liquiditätsteuerung und in Derivate, die für Investitionen und für ein effizientes Portfoliomanagement verwendet werden können.

Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Ein konkreter Referenzwert zur Beurteilung der Ausrichtung auf die beworbenen Merkmale existiert nicht.



sind

nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



- ***Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

- ***Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?***

Nicht zutreffend.



Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weiter produktspezifische Informationen sind auf folgender Website zu finden:

<https://www.structuredinvest.lu/de/en/fund-platform/esg.html>